

长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

2013

第四季度

报告

基金管理人:长盛基金管理有限公
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配方案、投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺,为基金份额持有人提供真实、准确、及时的信息披露,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	长盛沪深300指数(LOF)(场内简称:长盛300)
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月4日
报告期末基金份额总额	171.150,229.64份

本基金采取指数化投资,跟踪沪深300指数,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%,以实现对本基金指数的有效跟踪。

本基金采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性以及与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金投资组合,并优化调整投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。

业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

5.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期:2013年10月1日 - 2013年12月31日
1.本期已实现收益	-5,310,396.06
2.本期利润	-5,544,642.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0306
4.期末基金净值	134,125,629.58
5.期末基金净值增长率	0.78%

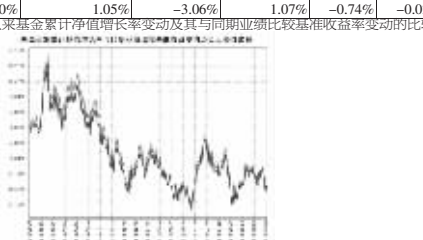
注:1.上述基金业绩指标不包括基金持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平低于所列数据。
2.所有数据截至到2013年12月31日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	业绩比较基准②	业绩比较基准收益③	①-③	②-④
过去三个月	-3.80%	1.05%	-3.06%	1.07%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来本基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期间,本基金的投资组合比例暂以符合本基金合同第十三条(二)投资组合比例限制为限。

代码

行业类别

公允价值(元)

占基金资产净值比例(%)

A	农、林、牧、渔业	916,522.77	0.68
B	采矿业	8,277,501.64	6.17
C	制造业	48,282,556.25	36.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,041,315.04	3.01
E	建筑业	4,796,690.23	3.58
F	批发和零售业	1,454,885.65	3.36
G	交通运输、仓储和邮政业	3,374,230.29	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,655,119.80	2.73
J	金融业	38,147,271.19	28.44
K	房地产业	6,880,286.07	5.13
L	租赁和商务服务业	904,315.19	0.67
M	科学研究和技术服务业	1,252,276.36	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	2,127,256.36	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	642,387.44	0.48
S	综合	1,360,201.36	1.01
合计		126,685,532.28	94.45

5.3.1 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	574,365	4,434,097.80	3.31
2	601318	中国平安	86,679	3,617,114.67	2.70
3	601166	兴业银行	348,133	3,530,068.62	2.63
4	600030	中信证券	209,659	2,673,152.25	1.99
5	600837	海通证券	230,019	2,603,815.08	1.94
6	600000	浦发银行	267,350	2,521,110.50	1.88
7	601328	交通银行	624,387	2,397,646.08	1.79
8	000002	格力电器	284,383	2,283,595.49	1.70
9	000651	方力科技	63,406	2,070,839.96	1.54
10	600887	伊利股份	41,843	1,635,224.44	1.22

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	549,872.70	0.41
8	其他	-	-
9	合计	549,872.70	0.41

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	4,970	533,032.50	0.40
2	113006	深燃转债	170	16,840.20	0.01

注:本基金本报告期末仅持有上述2支债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金股指期货投资的收益情况

注:本基金报告期内未进行股指期货投资的收益情况。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货的投资情况

5.9.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

4.1 基金经理 (或基金经理助理)简介			
姓名	职务	在本基金中的基金经理管理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限
冯国生	本基金基金经理, 长盛中证100指数证券投资基金基金经理	2011年12月20日	6年
<p>男, 1983年11月出生, 中国国籍。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司, 曾任长盛基金工程与量化投资部基金经理, 现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理, 长盛沪深300指数证券投资基金(LOF, 本基金基金经理助理。</p>			
<p>注: 1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指行业公认的公告聘任日期和离任日期。 2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从证监会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。</p>			
<p>4.2 管理人内部基金运作流程与情况的说明 本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及各项基金法规制, 《长盛沪深300指数证券投资基金》基金合同和具有约束力的法律文件, 监督受托人, 严格履行受托人义务, 确保基金财产的安全, 并严格执行风险控制程序, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 没有损害基金份额持有人利益的行为。</p>			
<p>4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况 报告期内, 公司严格执行《公司公平交易制》各项规定, 在研究、投资授权与决策、交易执行各个环节, 公平对待旗下所有投资组合, 包括公募基金、社保组合、专户组合等, 并得到信息技术部、研究支持、风控部等所有投资组合共享公司研究部门研究成果, 所有投资组合经理在公司公平交易平台上拥有同等权限。 4.3.2 公平交易制度的决策机制 公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制, 各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内, 独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。 交易执行, 公司实行集中交易制, 所有投资组合的委托指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《公司公平交易制》规定, 采用时间、金额、比例和恒生交易系统公平交易平台交易, 交易流程符合相关工作流程, 保证交易执行的公平性。 4.3.3 公平交易制度的监督与检查 投资管理过程中, 公司风险管理部、合规管理部、监察稽核部, 依照《公司公平交易制》的规定, 持续、动态地对投资组合公平执行情况进行检查, 监督投资组合是否存在违规问题, 同时对公司所有投资组合的公平交易情况进行检查。 4.3.4 公平交易制度的分析评价 公司通过过去 4 个季度内所有投资组合为进行数量分析, 计算选股率、赢利率、占优比指标, 使用双向 30 日滚动窗口, 已对过去 6 个月度内所有投资组合进行了公平交易分析。 4.3.2 异常交易行为的专项说明 报告期内, 本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易, 未发现有日反向交易或交易所申报的异常交易行为或可能影响公平交易的行为。 4.3.4 报告期内基金投资运作分析 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 四季度股票市场震荡上行, 油气改革、食品安全和环保等板块涨幅靠前, 而文化传媒、互联网金融等领域则受较大调整。行业上, 家用电器、食品饮料和机械设备等行业涨幅靠前, 信息服务、有色金属和医药生物等行业涨幅靠后。 在操作中, 我们严格遵守基金合同, 在指数权重调整和基金申赎变动时, 应指数权重制和数量化手段降低跟踪成本并减少跟踪误差。 4.4.2 报告期内基金业绩比较基准 截止报告期末, 本基金份额净值 70.784 元, 本报告期份额净值增长率为 7.03%, 同期业绩比较基准增长率为 -3.06%。本报告期末净值跟踪误差为 0.0635%, 年化跟踪误差率为 1.38%。</p>			
5.1 报告期末基金资产组合情况			
5.2 投资组合报告			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	126,685,532.28	93.85
	其中: 股票	126,685,532.28	93.85
2	固定收益投资	549,872.70	0.41
	其中: 债券	549,872.70	0.41
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	6,741,568.34	4.99
6	其他资产	1,013,397.85	0.75
7	合计	134,990,371.17	100.00

E3 报告期末按行业分类的股票投资组合
E.2.1 报告期末按资产配置行业行业的股票投资组合

长盛基金管理有限责任公司
2014年10月2日

基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2014年10月2日

§1 重要提示

基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年11月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的投资本金不受损失。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 产品基本情况

基金简称	长盛电子信息产业股票
基金代码	080012
交易代码	080012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月27日
报告期末基金份额总额	1,060,660,981.01份
投资目标	本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)分析宏观经济运行状况、市场估值水平等因素，动态调整权益资产在各类别资产间的分配比例；控制市场风格、提高配置效率。(2)发挥基金管理人研究团队和投研团队的“自上而下”的主动选股能力，判断公司的核心价值与成长性，从而选择具有竞争优势且价格有吸引力的公司作为投资标的，根据市场波动情况精选个股，构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%×中证信息技术指数收益率 + 20%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属于高风险、高预期收益的基金产品类型。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	79,671,199.92	
2.本期利润	63,608,613.91	
3.加权平均基金份额本期利润	0.1081	
4.期末基金净值	1,244,378,963.55	
5.期末基金份额净值	1.173	

注:1.所述基金净值指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后形成的净值水平要低于列示数字。
2.所谓当期利润为本期已实现的损益。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益及其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关税费后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 差值②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率差 值④	①-③	②-④
过去三个月	7.23%	1.42%	-2.17%	1.37%	9.40%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效之日起至本报告期末期间内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛电子信息产业

[2013]第 三季报

金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四条(二)投资组合范围、(八)投资限制以及有关限制的合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王克玉	本基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同庆蓝筹主题股票型证券投资基金基金经理,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,长盛创新驱动基金基金经理,长盛益利保本混合基金基金经理,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理	2012年3月27日		10年	男,1979年12月出生,中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大证券股份有限公司研究员,天相投资公司北京分公司分析师,国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任高级行业研究员、曾担任基金基金经理助理,同时负责长盛基金基金经理等职务;现任长盛投资管理有限公司副总经理兼证券投资部副经理、长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理、长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理。

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司董事会批准的日期;
2.“证券从业年限”中“证券从业资格”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司严格执行《公司公平交易机制》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

4.3.2 异常交易的专项说明

投资授权与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立行使投资组合的管理权力。各投资组合经理遵守投资行为明确制度,交易时间、公司等事项统一由集中交易系统处理,并制定统一的交易策略—执行交易流程、交易审批流程(公平公开透明原则)的执行、场内交易、场外交易、场外申购赎回业务系统平台进行,杜绝场外交易、场外交易、场外交易等相关工作疏漏,保证交易执行的公平性。

投资管理:公司建立了严格的风险管理制度,实施风险监控,依据《公司公平交易机制》的有关规定,定期监督各子投资组合是否合规,并进行公平评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司所有投资组合均处于公平对待。

公司对过去4个季度的双向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平下,3日、5日的交易片断进行交易检验,未发现违反公平交易利益输送的行为。

4.3.3 异常交易的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易经交易所公开竞价交易,未发现有反向交易成交较多的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,沪深两市震荡上行,创业板呈现小幅的上跌,各类品种的涨幅基本接近,其中上证综指和HS300指数分别下跌2.70%和3.28%,而创业板指数受到IPO重启等因素的影响,季度下降4.64%,成为年内唯一下跌的季度。4季度表现较好的行业主要是基本面良好但低估值的家电、交通运输、农业、纺织服装机械等行业,上半年超预期的行业则属T3季度的医药走势。4季度信息服务行业跌幅达到12.07%,主要受利空因素刺激大幅回落所致,而前期强势的计算机行业也出现回调迹象,难以持续的短期趋势。

4季度本基金的净值上涨2.23%,相对于业绩比较基准和市场整体体现出一定的领先,主要是由于在本季度投资组合仓位较满,尽管仍保持较为谨慎的行业配置,但在总体仓位下降的环境下仍能取得过程相对平稳净值的回撤幅度较小,从11月中旬市场的反弹来看的表现也基本跟上市场的表现。

4.4.2 报告期内基金的投资业绩

注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起每6个月内使基金的投资组合比例符合基金

长盛动态精选证券投资基金

2013 第四季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金注册登记机构保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21日复核了本基金报告期内的财务报表和净值表现及投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的投资本金不受损失。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期间自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛动态精选混合
基金代码	510081
交易代码	510081
前端交易代码	510081
后端交易代码	511081
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月21日
报告期末资产总额	946,636,332.32份

本基金通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的,在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票,在承担适度风险的前提下,追求当期收益和基金资产超越业绩比较基准的长期稳定回报。

本基金投资策略上偏重成长型资产的发育,时机的选择放在次要位置。

业绩比较基准:中信标普A股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中的适度风险品种,在承担适度风险的前提下,获取长期稳定的收益。

基金管理人:长盛基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	32,097,375.47	
2.本期利润	-28,700,084.95	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0298	
4.期末基金份额净值	971,544,957.82	
5.期末基金净值增长率	1.0263	

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.业绩比较基准上到2013年12月31日。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金名称	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准
长盛动态精选混合	1.0263	1.0263	1.0263

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 采矿业	10,039,714.49	1.03	-
C 制造业	570,950,017.57	58.77	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	11,790,256.26	1.21	-
F 批发和零售业	19,497,231.12	2.01	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	47,940,184.23	4.93	-
J 金融业	1,851.30	0.00	-
K 房地产业	-	-	-
L 租赁和商务服务业	-	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	22,652,158.47	2.33	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	-
P 教育	-	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	682,871,413.44	70.29	-

6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	1,483,121	71,199,808.00	7.33
2	002318	久立特材	2,250,092	40,726,646.80	4.15
3	600276	恒顺医药	1,008,850	38,361,123.00	3.94
4	000895	双汇发展	800,430	37,684,244.40	3.88
5	000581	威孚高科	1,201,836	37,016,548.80	3.81
6	600887	伊利股份	750,706	29,337,590.48	3.02
7	600315	上海家化	502,551	21,222,728.73	2.18
8	600389	江山股份	533,801	20,887,633.13	2.15
9	600079	人福医药	708,445	20,084,415.75	2.07
10	600588	用友软件	1,399,858	19,374,034.72	1.99

6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	18,624,000.00	1.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,943,000.00	12.35
其中:政策性金融债	119,943,000.00	12.35	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	138,567,000.00	14.26

前次	基金净值增长率(%)	基准差②	收益③	收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.79%	1.11%	-1.87%	1.11%	-0.92%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来某基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图例：本基金（即大成中证新兴产业指数证券投资基金）的基金净值增长率；中证新兴产业指数（即中证新兴产业指数证券投资基金跟踪的投资标的）的收益率。

4.1 基金经理（或基金经小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
男，1971年7月出生，中国国籍。毕业于山西农业大学，获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金助理。2005年7月底加入金鹰基金担任基金经理至今。					

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	900,000	89,991,000.00	9.26
2	130210	13国开10	300,000	29,995,000.00	3.08
3	010213	02国债03	200,000	18,624,000.00	1.92

注：本基金本报告期未持有上述3只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行股指期货投资，报告期无股指期货持仓。

5.8.2 本基金股指期货投资的收益情况

注：本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行国债期货投资，报告期无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注：本基金报告期内未进行国债期货投资。

[illegible]

基金定期报告按行业分类的股票投资组合 2016.02.03 100.00 2014年1月22日

股票型证券投资基金

四季度报告

截至报告期末,本基金份额净值为1.173元,本报告期份额净值增长率为7.23%,业绩比较基准收益率为-2.17%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	913,741,599.03	70.62
1	其中:股票	913,741,599.03	70.62
2	固定收益投资	-	-
2	其中:债券	-	-
3	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	208,300,000.00	16.10
4	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	84,229,162.85	6.51
6	其他资产	87,639,094.46	6.77
7	合计	1,293,099,856.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	539,865,375.22	43.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,159,919.14	0.41
E	建筑业	33,703,778.90	2.71
F	批发和零售业	2,835,727.72	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	2,796,700.85	0.22
H	信息和软件业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	326,535,711.83	26.24
J	金融业	1,464,827.97	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	166,692.40	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,212,865.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	913,741,599.03	73.43

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600050	中国联通	22,986,800	73,787,628.00	5.93
2	002138	顺络电子	2,638,710	45,491,360.40	3.66
3	300241	瑞丰光电	3,695,683	41,169,908.62	3.31
4	002484	江海股份	1,600,921	32,354,613.41	2.60
5	002465	海格通信	1,528,187	31,755,725.86	2.55
6	300207	欣旺达	1,428,357	31,352,436.15	2.52
7	300188	美亚光电	1,809,708	31,126,977.60	2.50
8	002063	远光软件	1,599,780	31,115,721.00	2.50
9	300077	开普科技	360,620	30,554,514.00	2.45
10	600522	中天科技	2,787,647	30,441,105.24	2.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期末基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	354,526.83
2	应收证券清算款	35,065,511.75
3	应收股利	-
4	应收利息	128,558.53
5	应收申购款	52,090,297.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,639,094.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明